

Central Daily Market Report

2024年10月25日(金)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位: 億円	2024年10月25日 需給速報	2024年10月28日 需給予想	2024年10月29日 当社予想		
銀行券	▲ 500	▲ 100	▲ 500		
財政	1,700	3,400	1,000		
資金過不足	1,200	3,300	500		
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	
貸出					
全店共通					
国債買現					
国債売現					
国庫短期証買入					
国債買入					
CP等買入		▲ 400	▲ 700		
貸出支援基金(成)					
貸出支援基金(貸)					
被災地支援					
社債等買入		▲ 700	▲ 600		
気候変動対応オペ					
E T F 買入					
国債補完供給	▲ 6,700	6,100	6,700		
当預増減	▲ 500	8,700	500		
当座預金残高	5,487,500	5,496,200	5,496,700		
準備預金残高	4,914,200				
積み終了先	4,912,900			10月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,912,700			積数	7.200
非準備預金先	573,300			1日平均	400
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					4,041,000
準備預金進捗率	実績	99.82%	日数	38.71%	

●2024年10月25日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、週末3日積みとなった事により調達ニーズがやや高まる展開となったものの、既にレートは高値圏での推移が続いている為、水準に大きな変化は見られず、引き続き0.225~0.227%程度の横這い圏での取引となった。ターム物はショートターム物を中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.235~0.245%程度での出会いとなった。
SCIは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

25日はTB3M物(第1265回)の入札が実施され、引き続き強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかり推移した。この他、6M物と1Y物でも少額の出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏となる0.25%以上で推移し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

2024/10/25	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	0.221	0.228	0.227				-	0.240
T/N							-	0.239
S/N							-	-
1W							-	0.204
2W			0.290				-	0.203
3W			0.290				-	0.203
1M			0.300				-	0.205
3M			0.320				0.012	0.213
6M							0.104	0.276
1Y							0.305	0.329

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.945	▲ 0.010	37,913.92	▲ 229.37	151.77-79	151.94-96
日付	10/18	10/21	10/22	10/23	10/24
日銀当預残	5,477,100	5,494,500	5,489,300	5,484,800	5,488,000
準備預金残	4,903,700	4,901,600	4,901,700	4,912,300	4,919,100
マネタリーベース	6,717,400	6,735,300	6,730,500	6,726,200	6,730,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	114,615	111,134	111,507	110,719	111,431
うち無担	75,151	72,312	73,067	73,026	73,201
うちO/N	28,981	25,372	25,977	25,776	25,801
うち有担	39,464	38,822	38,440	37,693	38,230

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1265	-	43,000	2024/10/28	2025/2/3	107,273	33,600.3	99.9980	0.0074%	87.8957%	99.9997	0.0011%	9,399

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応募総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/10/25	2024/10/28	▲0.050	6,859	6,859		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/25	2024/10/28	▲0.050	0	0				

●2024年10月28日の予定

*特にありません

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂く場合があります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入